

Maestría en Economía – FCE – UNLP
Econometría Avanzada 2024
Programa de la primera parte de la materia

Profesores:

- Profesor: Carlos Lamarche (email: clamarche@uky.edu; página web: carloslamarche.com)
Asistentes: Agostina Zulli (agostinazulli@gmail.com) y Matías Maljar (mmaljar@hotmail.com)

Fechas y horarios de clases:

- Prof. Lamarche:
 - Clases presenciales: 5/06, 12/06, 19/06 y 26/06, de 17 a 20hs.
 - Material de lectura: disponible en el aula virtual a partir de 01/06

Programa

Clase	Temario	Material: libro, capítulo, y videos
1	El modelo lineal: Esperanzas condicionales, efectos parciales promedios y elasticidades. Supuestos clásicos y Teorema de Gauss Markov. Estimación: mínimos cuadrados ordinarios y método de momentos. Proyecciones y teorema de Frish-Waugh y Lovell. Sesgo. Estimación de la varianza bajo distintos supuestos. Variables omitidas. Inferencia.	Notas de clase, WO 1 & 2 DM 2 & 3
2	Teoría de las muestras grandes: Teoría asintótica como herramienta. Resultados de convergencia, ley de los grandes números y teorema de los grandes números. Consistencia y distribución asintótica de estimadores clásicos.	Notas de clase, WO 3, HA 2
3	Variabes Instrumentales: Endogeneidad: ejemplos básicos. Estimación de variables instrumentales y método de dos etapas. Propiedades de muestra grande. Instrumentos débiles y sesgos. Sobre identificación y test. Sistema de ecuaciones.	Notas de clase, WO 5 & 8, AP 10
4	Método de Momentos Generalizados: Definiciones básicas. Estimador de MMG: consistencia y distribución asintótica. Máxima Verosimilitud: Máxima verosimilitud y score. Estimador de máxima verosimilitud: consistencia y distribución asintótica. Estimador de máxima verosimilitud restringido.	Notas de clase, WO 13 y 14, HA 3 Notas de clase, DM 10, HA 7

Material de lectura: En el aula virtual se puede acceder a notas de clase y videos correspondientes a cada semana.

Libros: No hay libros de lectura obligatoria, pero los siguientes son una fuente útil de consulta:

- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data; Wooldridge, J. (2010), MIT Press (WO)
- Econometrics; Fumio Hayashi (2000), Princeton University Press (HA)
- Mostly Harmless Econometrics; Angrist, J., and Pischke, J-S. (2009), Princeton University Press (AP)
- Econometrics Theory and Methods; Davidson, R. and MacKinnon, J. G. (2004), Oxford University Press (DM)